

Tabela punktów swapowych TMS Prime

Obowiązuje w dniach 2018.09.10 - 2018.09.16. Opublikowane punkty swapowe są naliczane w minimalnym kroku notowań dla danego instrumentu.

Instrument	Długa pozycja	Krótka pozycja
EURUSD.pro	-10.3231	5.0815
CADCHF.pro	2.9314	-6.4077
CADJPY.pro	1.8959	-5.5947
CHFJPY.pro	-4.7413	-0.4441
EURCAD.pro	-11.4471	4.2825
EURCHF.pro	-1.4082	-4.0526
EURGBP.pro	-4.7459	0.8178
EURJPY.pro	-3.8230	-2.0009
GBPCAD.pro	-7.1103	-0.1373
GBPCHF.pro	2.6184	-8.1610
GBPJPY.pro	0.5148	-6.3835
GBPUSD.pro	-7.2257	1.9440
USDCAD.pro	-0.9154	-4.8704
USDCHF.pro	5.4053	-9.8250
USDJPY.pro	4.2586	-8.9491
AUDCHF.pro	3.3681	-7.0739
AUDCAD.pro	-1.3038	-3.5732
AUDJPY.pro	2.4833	-6.4614
AUDNZD.pro	-3.3280	-3.0259
AUDUSD.pro	-1.9978	-1.5826
CHFPLN.pro	-3.5050	1.5271
EURAUD.pro	-14.6759	6.0064
EURCZK.pro	-1.7448	0.3063

EURHUF.pro	-1.1270	-0.5592
EURNOK.pro	-5.3367	0.8896
EURNZD.pro	-16.2309	6.7888
EURPLN.pro	-3.4400	1.2168
EURSEK.pro	-2.2972	-3.1411
EURTRY.pro	-557.1357	332.0021
GBPAUD.pro	-10.3480	1.4684
GBPNZD.pro	-11.5457	1.8743
GBPPLN.pro	-2.2388	-0.0313
NZDJPY.pro	2.3806	-6.0332
NZDUSD.pro	-1.7434	-1.5438
USDCZK.pro	0.0000	-1.1752
USDHUF.pro	0.9344	-2.3057
USDNOK.pro	1.0941	-4.6799
USDPLN.pro	-0.4365	-1.3705
USDSEK.pro	4.1689	-8.5910
USDTRY.pro	-437.1201	244.5871
EURZAR.pro	-61.2441	14.3068
USDZAR.pro	-42.5685	2.4881
SILVER.pro	-0.9306	0.6315
GOLD.pro	-7.8293	5.3089
COPPER.pro	-0.3852	0.2612
EURUSD.std	-12.2527	3.1518
CADCHF.std	1.7015	-7.6379
CADJPY.std	0.4915	-6.9992
CHFJPY.std	-6.6442	-2.3471
EURCAD.std	-13.9910	1.7384
EURCHF.std	-3.2858	-5.9302

EURGBP.std	-6.2273	-0.6636
EURJPY.std	-5.9667	-4.1447
GBPCAD.std	-9.9331	-2.9603
GBPCHF.std	0.5351	-10.2444
GBPJPY.std	-1.8640	-8.7623
GBPUSD.std	-9.3669	-0.1972
USDCAD.std	-3.1125	-7.0676
USDCHF.std	3.7838	-11.4466
USDJPY.std	2.4071	-10.8006
AUDCHF.std	2.2134	-8.2288
AUDCAD.std	-2.8685	-5.1380
AUDJPY.std	1.1648	-7.7799
AUDNZD.std	-5.1433	-4.8414
AUDUSD.std	-3.1846	-2.7695
CHFPLN.std	-4.1386	0.8932
EURAUD.std	-17.3854	3.2967
EURCZK.std	-2.1722	-0.1211
EURHUF.std	-1.6679	-1.1003
EURNOK.std	-6.9539	-0.7278
EURNZD.std	-19.1821	3.8371
EURPLN.std	-4.1538	0.5029
EURSEK.std	-4.0420	-4.8860
EURTRY.std	-563.3654	325.7665
GBPAUD.std	-13.3545	-1.5384
GBPNZD.std	-14.8204	-1.4009
GBPPLN.std	-3.0307	-0.8235
NZDJPY.std	1.1701	-7.2438
NZDUSD.std	-2.8330	-2.6336

USDCZK.std	-0.3690	-1.5444
USDHUF.std	0.4672	-2.7730
USDNOK.std	-0.3026	-6.0769
USDPLN.std	-1.0529	-1.9871
USDSEK.std	2.6621	-10.0981
USDTRY.std	-442.4982	239.2056
EURZAR.std	-62.7086	12.8418
USDZAR.std	-43.8333	1.2230
SILVER.std	-1.0489	0.5131
GOLD.std	-8.8246	4.3135
COPPER.std	-0.4341	0.2123
3M	-2.7350	0.0000
AMAZON	-25.1115	0.0000
AIG	-0.6904	0.0000
APPLE	-2.8483	0.0000
AT&T	-0.4132	0.0000
BABA	-2.0887	0.0000
BOEING	-4.4950	0.0000
CHEVRON	-1.4742	0.0000
CISCO	-0.6054	0.0000
CITI	-0.8957	0.0000
COCACOLA	-0.5883	0.0000
EBAY	-0.4372	0.0000
EXXONM	-1.0527	0.0000
FACEBOOK	-2.0976	0.0000
GE	-0.1596	0.0000
GMOTORS	-0.4363	0.0000
GOOGLE	-15.1494	0.0000

IBM	-1.8713	0.0000
INTEL	-0.5978	0.0000
J&J	-1.7674	0.0000
JPMORGAN	-1.4705	0.0000
MCDONALD	-2.1085	0.0000
MICROSFT	-1.3929	0.0000
PFIZER	-0.5430	0.0000
P&G	-1.0536	0.0000
STBUCKS	-0.7057	0.0000
WALMART	-1.2330	0.0000
GOLDMAN	-3.0094	0.0000
UPS	-1.5823	0.0000
ALCOA	-0.5273	0.0000
AMERICANEXP	-1.3646	0.0000
BOA	-0.3970	0.0000
CATERPILLAR	-1.8181	0.0000
SNAP	-0.1279	0.0000
DISNEY	-1.4276	0.0000
FORD	-0.1192	0.0000
FEDEX	-3.1644	0.0000
HARLEY-DAVI	-0.5708	0.0000
HP	-0.2128	0.0000
NIKE	-1.0330	0.0000
PEPSI	-1.4503	0.0000
PM	-1.0111	0.0000
TWITTER	-0.3922	0.0000
VISA	-1.8425	0.0000
PAYPAL	-1.1428	0.0000

TESLA	-3.3862	0.0000
NETFLIX	-4.4860	0.0000
BASF	-4.4767	0.0000
DTELEKOM	-0.7959	0.0000
ALLIANZ	-10.6551	0.0000
BAYER	-4.2884	0.0000
BEIERSDO	-5.7299	0.0000
DAIMLERC	-3.1796	0.0000
DBANK	-0.5657	0.0000
SIEMENS	-6.3510	0.0000
LUFTHANS	-1.3012	0.0000
CECONOMY	-0.3760	0.0000
ADIDAS	-12.0703	0.0000
BMW	-4.7328	0.0000
COMMERZBANK	-0.4918	0.0000
CONTINENTAL	-8.8159	0.0000
HENKEL	-6.1843	0.0000
RWE	-1.2901	0.0000
THYSSEN	-1.1173	0.0000
VOLKSWAGEN	-7.8831	0.0000
BARCLAYS	-1.5601	0.0000
GSK	-13.4361	0.0000
M&S	-2.5799	0.0000
RBS	-2.2034	0.0000
ROLLS-ROYCE	-8.5714	0.0000
RIOTINTO	-31.1375	0.0000
SHELL	-21.5391	0.0000
STAN	-5.4648	0.0000

TESCO	-2.1115	0.0000
UNILEVER	-37.5277	0.0000
VODAFONE	-1.4707	0.0000
SANTANDER	-0.2484	0.0000
TELEFONICA	-0.3973	0.0000
BBVA	-0.3061	0.0000
IBERDOLA	-0.3687	0.0000
REPSOL	-0.9573	0.0000
CAIXABANK	-0.2348	0.0000
ABERTIS	-1.0695	0.0000
GASNATURAL	-1.3725	0.0000
REDELECTRIC	-1.0661	0.0000
GRIFOLS	-1.4211	0.0000
BANKINTER	-0.4509	0.0000
MAPFRE	-0.1473	0.0000
ACS	-2.0655	0.0000
AMADEUS	-4.4808	0.0000
INDITEX	-1.4673	0.0000
ACERINOX	-0.6588	0.0000
AENA	-8.3948	0.0000
BANKIA	-0.1964	0.0000
IAG	-0.4354	0.0000
SACYR	-0.1441	0.0000
TECNICAS	-1.6380	0.0000
ASHR.ETF	-0.3092	-0.0247
DBA.ETF	-0.2198	-0.0175
DBC.ETF	-0.2205	-0.0176
EEM.ETF	-0.5345	-0.0426

EFA.ETF	-0.8416	-0.0671
EWA.ETF	-0.2759	-0.0220
EWV.ETF	-0.6335	-0.0505
EWY.ETF	-0.8353	-0.0666
EWZ.ETF	-0.4177	-0.0333
FXI.ETF	-0.5263	-0.0419
GLD.ETF	-1.4563	-0.1161
HYG.ETF	-1.1026	-0.0879
IVV.ETF	-3.7255	-0.2968
IYR.ETF	-1.0556	-0.0841
OIH.ETF	-0.2984	-0.0238
SLV.ETF	-0.1712	-0.0137
SPY.ETF	-3.6990	-0.2947
SSO.ETF	-1.5956	-0.1272
SVXY.ETF	-0.1767	-0.0141
TBT.ETF	-0.4779	-0.0381
VNQ.ETF	-1.0660	-0.0850
VXX.ETF	-0.3971	-0.0317
XHB.ETF	-0.5143	-0.0410
XLB.ETF	-0.7590	-0.0605
XLE.ETF	-0.9364	-0.0746
XLF.ETF	-0.3642	-0.0290
XLI.ETF	-0.9981	-0.0795
XLP.ETF	-0.6992	-0.0557
XLU.ETF	-0.6958	-0.0555
XLV.ETF	-1.1904	-0.0949
XLY.ETF	-1.4868	-0.1185
BITCOIN	-122.4020	-53.2653

BTCUSD	-436.7010	-367.6178
ETHUSD	-136.0405	-114.5734
LTCUSD	-37.5914	-31.6802
BCHUSD	-33.2334	-27.9912
XRPUSD	-18.9798	-16.0038

Maksymalna wielkość marży na stopę procentową przy kalkulacji punktów swapowych została określona w Tabeli Opłat i Prowizji TMS Trader. Do ustalenia w/w Punktów Swapowych TMS Brokers zastosował marżę w wysokości:

TMS Prime	
Wysokość prowizji na stopy procentowe uwzględniana przy kalkulacji punktów swapowych	
EURTRY.std, USDTRY.std, EURZAR.std, USDZAR.std, EURTRY.pro, USDTRY.pro, EURZAR.pro, USDZAR.pro	4,00%
Akcje i ETF'y	2,50%
Pozostałe FX(.pro) oraz COPPER.pro, GOLD.pro, SILVER.pro	0,35%
Pozostałe FX(.std) oraz COPPER.std, GOLD.std, SILVER.std	0,65%
BITCOIN	5,00%
BTCUSD, ETHUSD, LTCUSD, BCHUSD, XRPUSD	23,00%

Wzory na obliczanie punktów swapowych CFD opartych o waluty, kryptowaluty, złoto, srebro oraz miedź (punkty swapowe dla CFD opartych o wartość kryptowalut, złota, srebra oraz miedzi są wyliczane w oparciu formułę właściwą dla wyznaczania punktów swapowych dla instrumentów o charakterze walutowym, z takim jednak zastrzeżeniem, że oprocentowanie wyznaczone jest tylko dla jednej waluty, w której kwotowany jest instrument bazowy).

$$long\ swap = -(kurs\ spot_{BID} \times \frac{(1 + (stopa\ \% \ waluty\ kwotowanej_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% \ waluty\ bazowej_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})} - kurs\ spot_{BID}) \times mnożnik$$

$$short\ swap = (kurs\ spot_{ASK} \times \frac{(1 + (stopa\ \% \ waluty\ kwotowanej_{BID} - marża) \times \frac{1}{T})}{(1 + (stopa\ \% \ waluty\ bazowej_{ASK} + marża) \times \frac{1}{T})} - kurs\ spot_{ASK}) \times mnożnik$$

long swap - wartość punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap – wartość punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

kurs spot BID,ASK – kurs danej pary walutowej w momencie kalkulowania punktów swapowych BID lub ASK;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

T - oznacza ilość dni wg przyjętej dla danej waluty konwencji (np. dla USD rok ma 360 dni, podczas gdy dla PLN 365 dni);

mnożnik - współczynnik wynikający z minimalnego kroku notowań, np. dla EURUSD minimalny krok notowań to 0.00001 dlatego mnożnik w przypadku kalkulacji punktów swapowych będzie wynosił 100 000;

stopa % waluty bazowej/kwotowanej BID,ASK - dla wyznaczania stopy procentowej TMS Brokers przyjmuje kwotowania z rynku międzybankowego na podstawie instrumentów przedstawionych w poniższej tabeli:

Waluta	Symbol w Bloomberg	Konwencja liczenia dni (T)	Nazwa stopy Procentowej
EUR	EUDR1Z CMPN Curncy	360	Euro 1 Week Deposit
USD	USDR1Z CMPN Curncy	360	United States Dollar 1 Week Deposit
PLN	PZDR1Z CMPN Curncy	365	Polish Zloty 1 Week Deposit
CAD	CDDR1Z CMPN Curncy	360	Canadian Dollar 1 Week Deposit
JPY	JYDR1Z CMPN Curncy	360	Japanese Yen 1 Week Deposit
GBP	BPDR1Z CMPN Curncy	365	British Pound 1 Week Deposit
CHF	SFDR1Z Curncy	360	Swiss Franc 1 Week Deposit
AUD	ADDR1Z CMPN Curncy	360	Australian Dollar 1 Week Deposit

NZD	NDDR1Z CMPN Curncy	360	New Zealand Dollar 1 Week Deposit
CZK	CKDR1Z Curncy	360	Czech Koruna 1 Week Deposit
SEK	SKDR1Z Curncy	360	Swedish Krona 1 Week Deposit
NOK	NKDR1Z Curncy	360	Norwegian Krone 1 Week Deposit
ZAR	SADR1Z CURRENCY	360	South African Rand 1 Week Deposit
HUF	HFDR1Z Curncy	360	Hungarian Forint 1 Week Deposit
RON	RNDR1Z CMPN Curncy	360	Romanian Leu 1 Week Deposit
HKD	HDDR1Z Curncy	360	Hong Kong Dollar 1 Week Deposit
TRY	TYDR1Z CMPN Curncy	360	Turish Lira 1 Week Deposit
MXN	MXNI1M CMPN Curncy	360	Mexican Peso 1 Month Froward Implied Yeld

Przykład.

Kalkulacja dla EURUSD

kurs spot BID : 1,2114

kurs spot ASK : 1,2115

T: 360

Marża: 0,65%

stopa % waluty bazowej BID : -0,5%

stopa % waluty bazowej ASK : -0,37%

stopa % waluty kwotowanej BID : 1,74%

stopa % waluty kwotowanej ASK : 1,82%

$$long\ swap = - \left(1,2114 \times \frac{(1 + (1,82\% + 0,65\%) \times \frac{1}{360})}{(1 + ((-0,5\%) - 0,65\%) \times \frac{1}{360})} - 1,2114 \right) \times 100000 = -12,1817$$

$$short\ swap = \left(1,2115 \times \frac{\left(1 + (1,74\% - 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)}{\left(1 + ((-0,37\%) + 0,65\%) \times \frac{1}{360} \right)} - 1,2115 \right) \times 100000 = 2,7259$$

Wzory na obliczanie punktów swapowych dla CFD opartych o wartość akcji i ETF. W przypadku, gdy dla CFD opartych o wartość akcji punkty swapowe dla pozycji krótkiej są ujemne, przyjmujemy wartość 0.

$$long\ swap = -kurs\ spot_{BID} \left((stopa\ \% + marża) \times \frac{1}{T} \right) \times mnożnik$$

$$short\ swap = kurs\ spot_{ASK} \left((stopa\ \% - marża) \times \frac{1}{T} \right) \times mnożnik$$

long swap - wartość punktów swap naliczanych dla pozycji długiej;

short swap – wartość punktów swap naliczanych dla pozycji krótkiej;

kurs spot BID,ASK – kurs danej pary walutowej w momencie kalkulowania punktów swapowych BID lub ASK;

marża – wielkość prowizji, jaką TMS Brokers nakłada na stopę procentową;

T - oznacza ilość dni wg przyjętej dla danej waluty konwencji (np. dla USD rok ma 360 dni, podczas gdy dla PLN 365 dni);

mnożnik – współczynnik wynikający z minimalnego kroku notowań, np. dla EURUSD minimalny krok notowań to 0.00001 dlatego mnożnik w przypadku kalkulacji punktów swapowych będzie wynosił 100 000;

stopa % waluty kwotowanej BID,ASK - dla wyznaczania stopy procentowej TMS Brokers przyjmuje kwotowania z rynku międzybankowego na podstawie instrumentów przedstawionych w poniższej tabeli:

Waluta	Ticker w Bloomberg	Konwencja liczenia dni (T)	Opis
USD	US0001M Index	360	ICE LIBOR USD 1 Month
EUR	EE0001M Index	360	ICE LIBOR EUR 1 Month
PLN	WIBR1M Index	365	GPW Benchmark WIBOR PLN 1 Month
GBP	BP0001M Index	365	ICE LIBOR GBO 1 Month

